


Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце: МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФИО: Силин Яков Петрович
Должность: Ректор
Дата подписания: 11.10.2023 14:42:15
Уникальный программный ключ:
24f866be2aca16484036884b35090511f605f

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФГБОУ ВО «Уральский государственный экономический университет»

Одобрена
21.11.2022 г.
протокол № 4
Зав. кафедрой Юзович Л.И.

Утверждена
Советом по учебно-методическим
вопросам и качеству образования
14 декабря 2022 г.
протокол № 4
Председатель  Карх Д.А.



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование дисциплины	Производные финансовые инструменты
Направление подготовки	38.03.01 Экономика
Профиль	Финансы и кредит
Форма обучения	очная
Год набора	2023
Разработана: Доцент, к.э.н. Татьянников В.А.	

Екатеринбург
2022 г.

СОДЕРЖАНИЕ

ВВЕДЕНИЕ	3
1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	3
2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП	3
3. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ	3
4. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ОПОП	3
5. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН	9
6. ФОРМЫ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ШКАЛЫ ОЦЕНИВАНИЯ	10
7. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ	12
8. ОСОБЕННОСТИ ОРГАНИЗАЦИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ	15
9. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	16
10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ЛИЦЕНЗИОННОГО ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ОНЛАЙН КУРСОВ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ	17
11. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ	17

ВВЕДЕНИЕ

Рабочая программа дисциплины является частью основной профессиональной образовательной программы высшего образования - программы бакалавриата, разработанной в соответствии с ФГОС ВО

ФГОС ВО	Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 954)
ПС	

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Формирование компетенций, направленных на получение системы знаний о функционировании рынка стандартных контрактов, видах производных финансовых инструментов, участниках срочного рынка и их функциях, возможностях применения основных стратегий хеджирования, спекуляции и арбитражирования на основе фьючерсных и опционных контрактов.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина относится к вариативной части учебного плана.

3. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ

Промежуточный контроль	Часов					З.е.
	Всего за семестр	Контактная работа (по уч.зан.)			Самостоятельная работа в том числе подготовка контрольных и курсовых	
		Всего	Лекции	Практические занятия, включая курсовое проектирование		
Семестр 8						
Экзамен	180	32	16	16	112	5

4. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ОПОП

В результате освоения ОПОП у выпускника должны быть сформированы компетенции, установленные в соответствии ФГОС ВО.

Профессиональные компетенции (ПК)

Шифр и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенций
финансовый	

<p>ПК-7 Совершение сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами по поручению клиента на основе анализа состояния рынка ценных бумаг, рынка производных финансовых инструментов с учетом финансового консультирования и внутреннего учета сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами</p>	<p>ИД-1.ПК-7 Знать:</p> <p>Основы гражданского законодательства Российской Федерации, законодательство Российской Федерации о рынке ценных бумаг; Организацию торговли на биржевых рынках России и других стран; Технологию заключения и исполнения сделок с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами на биржевом и внебиржевом рынке; Текущее состояние рынка ценных бумаг, производных финансовых инструментов, других сегментов финансового рынка; Нормативные акты, регламентирующие заключение и исполнение сделок с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами; Специализированные компьютерные программы; Этику делового общения и правила деловой переписки; Методы и инструменты экономического и финансового анализа; Принципы составления бухгалтерской отчетности, в том числе по международным стандартам финансовой отчетности (МСФО); Методы и инструменты оценки эмитента и ценных бумаг эмитента; Иностраный язык (английский) в области ценных бумаг; Методы и способы защиты информации; Технологии совершения сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами и их отражение в регистрах внутреннего учета.</p>
	<p>ИД-2.ПК-7 Уметь:</p> <p>Составлять гражданско-правовые договоры, работать с документами; Применять информационно-коммуникационные технологии; Проводить технический анализ при совершении сделок с ценными бумагами и применять иные финансовые инструменты; Вести деловые переговоры; Производить экономический и финансовый анализ компании; Производить анализ финансового рынка и его отдельных сегментов; Консультировать клиентов, взаимодействовать с клиентами</p>

<p>ПК-7 Совершение сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами по поручению клиента на основе анализа состояния рынка ценных бумаг, рынка производных финансовых инструментов с учетом финансового консультирования и внутреннего учета сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами</p>	<p>ИД-3.ПК-7 Иметь практический опыт: Продажи услуг брокерской компании, заполнение реквизитов договоров с клиентами; Информирования клиентов - физических лиц о правах и гарантиях в соответствии с законодательством Российской Федерации о защите прав инвесторов; Письменного уведомления клиента при заключении договора о рисках, связанных с осуществлением операций на рынке ценных бумаг; Заключения в интересах клиентов сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами и исполнение обязательств по ним; Хранения, использования и учета денежных средств клиента, предназначенных для инвестирования в ценные бумаги или полученные от продажи ценных бумаг; Представления клиенту отчетов о ходе исполнения договора, выписки по движению денежных средств и ценных бумаг по учетным счетам, иные документы, связанные с исполнением договора; Макроэкономического анализа, анализа отраслей, секторов экономики; Фундаментального анализа эмитентов и их ценных бумаг; Анализа инвестиционных проектов, окупаемости проектов; Оценки эмитента и ценных бумаг эмитента; Подготовки предложений по совершению сделок с ценными бумагами эмитентов; Консультирования эмитента по вопросам эмиссии эмиссионных ценных бумаг, по составлению проспекта ценных бумаг; Консультирования по поводу раскрытия информации эмитентом, осуществляющим публичное размещение/обращение эмиссионных ценных бумаг; риема и исполнения документов, на основании которых осуществляется внутренний учет сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами; Передачи информации в рамках внутреннего учета сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами; Ведение регистров внутреннего учета; Хранение первичных документов, на основании которых осуществляется ведение регистров внутреннего учета.</p>
---	---

<p>ПК-8 Совершение сделок купли-продажи ценных бумаг от своего имени и за свой счет на основе анализа состояния рынка ценных бумаг, рынка производных финансовых инструментов с применением внутреннего учета сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами</p>	<p>ИД-1.ПК-8 Знать:</p> <p>Основы гражданского законодательства Российской Федерации, законодательство Российской Федерации о рынке ценных бумаг; Особенности организации торговли на биржевых рынках России и других стран;</p> <p>Технологию заключения и исполнения сделок с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами на биржевом и внебиржевом рынке;</p> <p>Текущее состояние рынка ценных бумаг, производных финансовых инструментов, других сегментов финансового рынка;</p> <p>Нормативные акты, регламентирующие заключение и исполнение сделок с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами;</p> <p>Специализированные компьютерные программы;</p> <p>Этику делового общения и правила деловой переписки;</p> <p>Методы и инструменты экономического и финансового анализа;</p> <p>Принципы составления бухгалтерской отчетности, в том числе по международным стандартам финансовой отчетности (МСФО);</p> <p>Методы и инструменты оценки эмитента и ценных бумаг эмитента;</p> <p>Иностранный язык (английский) в области ценных бумаг;</p> <p>Технологии совершения сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами и их отражение в регистрах внутреннего учета.</p>
	<p>ИД-2.ПК-8 Уметь:</p> <p>Составлять гражданско-правовые договоры, работать с документами;</p> <p>Использовать компьютерные технологии;</p> <p>Проводить технический анализ при совершении сделок с ценными бумагами и применять иные финансовые инструменты;</p> <p>Проводить деловые переговоры, работать с контрагентами;</p> <p>Производить экономический и финансовый анализ компании;</p> <p>Производить анализ финансового рынка и его отдельных сегментов;</p> <p>Использовать компьютерные технологии, специализированные компьютерные программы.</p>

<p>ПК-8 Совершение сделок купли-продажи ценных бумаг от своего имени и за свой счет на основе анализа состояния рынка ценных бумаг, рынка производных финансовых инструментов с применением внутреннего учета сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами</p>	<p>ИД-3.ПК-8 Иметь практический опыт: Заклучения в интересах клиентов сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами и исполнение обязательств по ним; Заклучения сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами путем объявления цен покупки/продажи с обязательством покупки/продажи по объявленным ценам (котировка ценных бумаг и производных финансовых инструментов), в том числе в порядке выполнения функции маркетмейкера; Предоставление контрагентам информации и документов, относящихся к обращению ценных бумаг, к совершению и исполнению сделок с контрагентами; Макроэкономического анализа, анализа отраслей, секторов экономики; Фундаментального анализа эмитентов и их ценных бумаг; Анализа инвестиционных проектов, окупаемости проектов; Оценки эмитента и ценных бумаг эмитента; Подготовки предложений по совершению сделок с ценными бумагами эмитентов; Приема и исполнения документов, на основании которых осуществляется внутренний учет сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами; Передачи информации в рамках внутреннего учета сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами; Ведение регистров внутреннего учета; Хранение первичных документов, на основании которых осуществляется ведение регистров внутреннего учета</p>
--	---

<p>ПК-9 Доверительное управление ценными бумагами и иными активами на основе анализа состояния рынка ценных бумаг, рынка производных финансовых инструментов с учетом консультационных услуг в области инвестиций и внутреннего учета сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами</p>	<p>ИД-1.ПК-9 Знать:</p> <p>Основы гражданского законодательства Российской Федерации, законодательство Российской Федерации о рынке ценных бумаг; Особенности организации торговли на биржевых рынках России и других стран;</p> <p>Технологию заключения и исполнения сделок с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами на биржевом и внебиржевом рынке;</p> <p>Текущее состояние рынка ценных бумаг, производных финансовых инструментов, других сегментов финансового рынка;</p> <p>Нормативные акты, регламентирующие заключение и исполнение сделок с ценными бумагами и иными финансовыми инструментами;</p> <p>Специализированные компьютерные программы;</p> <p>Этику делового общения и правила деловой переписки;</p> <p>Методы и инструменты экономического и финансового анализа;</p> <p>Принципы составления бухгалтерской отчетности, в том числе по международным стандартам финансовой отчетности (МСФО);</p> <p>Методы и инструменты оценки эмитента и ценных бумаг эмитента;</p> <p>Иностранный язык (английский) в области ценных бумаг;</p> <p>Законодательство Российской Федерации по ценным бумагам, по защите прав инвесторов и акционеров, о деятельности институтов коллективного инвестирования;</p> <p>Текущая конъюнктура рынка ценных бумаг;</p> <p>Методы и способы защиты информации;</p> <p>Технологии совершения сделок с ценными бумагами и производными финансовыми инструментами и их отражение в регистрах внутреннего учета.</p>
	<p>ИД-2.ПК-9 Уметь:</p> <p>Составлять гражданско-правовые договоры, работать с документами;</p> <p>Использовать компьютерные технологии;</p> <p>Проводить технический анализ при совершении сделок с ценными бумагами и применять иные финансовые инструменты;</p> <p>Проводить деловые переговоры, работать с контрагентами;</p> <p>Производить экономический и финансовый анализ компании;</p> <p>Производить анализ финансового рынка и его отдельных сегментов;</p> <p>Использовать информационные и компьютерные технологии;</p> <p>Проводить консультации клиентов, взаимодействовать с клиентами;</p> <p>Работать с нормативными документами, большими объемами информации.</p>

Семестр 8		144					
Тема 1.	Срочный рынок: сущность, функции, ключевые игроки, инфраструктура (ПК-8)	16	2		4	10	
Тема 2.	Основные виды производных финансовых инструментов (ПК-9)	18	2			16	
Тема 3.	Фьючерсный контракт: сущность, особенности обращения (ПК-7)	18	2			16	
Тема 4.	Опционный контракт: сущность, виды, внутренняя и временная стоимость (ПК-7)	18	2		4	12	
Тема 5.	Ценообразование фьючерсных и опционных контрактов (ПК-9)	18	2		4	12	
Тема 6.	Коэффициенты оценки опционов (ПК-8)	18	2			16	
Тема 7.	Хеджирование фьючерсными и опционными контрактами (ПК-8)	20	2			18	
Тема 8.	Клиринг и расчеты на биржевом рынке стандартных контрактов (ПК-9)	18	2		4	12	

6. ФОРМЫ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ШКАЛЫ ОЦЕНИВАНИЯ

Раздел/Тема	Вид оценочного средства	Описание оценочного средства	Критерии оценивания
Текущий контроль (Приложение 4)			
Тема 1,2,6,8	Коллоквиум (Приложение 4)	Владение понятийным аппаратом, умение вести аргументированное обсуждение вопросов темы.	10 баллов
Тема 4,5	Проект (Приложение 4)	Проект оценивается по следующим критериям: - актуальность материала; - логика, четкость изложения; - обоснованность сформулированных выводов.	10 баллов
Тема 7	Тест (Приложение 4)	Количество вопросов -10. По 1 баллу за каждый правильный ответ.	10 баллов
Тема 3	Индивидуальное задание (Приложение 4)	Предусматривает решение практической задачи согласно индивидуального варианта на вычисление начальной, вариационной маржи при купле/продаже фьючерсных контрактов на бирже.	10 баллов
Промежуточный контроль (Приложение 5)			
8 семестр (Эк)	Экзаменационный билет (Приложение 5)	Экзаменационный билет содержит два теоретических вопроса и одно практическое задание	100 баллов

ОПИСАНИЕ ШКАЛ ОЦЕНИВАНИЯ

Показатель оценки освоения ОПОП формируется на основе объединения текущей и промежуточной аттестации обучающегося.

Показатель рейтинга по каждой дисциплине выражается в процентах, который показывает уровень подготовки студента.

Текущая аттестация. Используется 100-балльная система оценивания. Оценка работы студента в течение семестра осуществляется преподавателем в соответствии с разработанной им системой оценки учебных достижений в процессе обучения по данной дисциплине.

В рабочих программах дисциплин и практик закреплены виды текущей аттестации, планируемые результаты контрольных мероприятий и критерии оценки учебных достижений.

В течение семестра преподавателем проводится не менее 3-х контрольных мероприятий, по оценке деятельности студента. Если посещения занятий по дисциплине включены в рейтинг, то данный показатель составляет не более 20% от максимального количества баллов по дисциплине.

Промежуточная аттестация. Используется 5-балльная система оценивания. Оценка работы студента по окончании дисциплины (части дисциплины) осуществляется преподавателем в соответствии с разработанной им системой оценки достижений студента в процессе обучения по данной дисциплине. Промежуточная аттестация также проводится по окончании формирования компетенций.

Порядок перевода рейтинга, предусмотренных системой оценивания, по дисциплине, в пятибалльную систему.

Высокий уровень – 100% - 70% - отлично, хорошо.

Средний уровень – 69% - 50% - удовлетворительно.

Показатель оценки	По 5-балльной системе	Характеристика показателя
100% - 85%	отлично	обладают теоретическими знаниями в полном объеме, понимают, самостоятельно умеют применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов на высоком уровне
84% - 70%	хорошо	обладают теоретическими знаниями в полном объеме, понимают, самостоятельно умеют применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов. Могут быть допущены недочеты, исправленные студентом самостоятельно в процессе работы (ответа и т.д.)
69% - 50%	удовлетворительно	обладают общими теоретическими знаниями, умеют применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов на среднем уровне. Допускаются ошибки, которые студент затрудняется исправить самостоятельно.
49 % и менее	неудовлетворительно	обладают не полным объемом общих теоретическими знаниями, не умеют самостоятельно применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов. Не сформированы умения и навыки для решения профессиональных задач
100% - 50%	зачтено	характеристика показателя соответствует «отлично», «хорошо», «удовлетворительно»
49 % и менее	не зачтено	характеристика показателя соответствует «неудовлетворительно»

7. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

7.1. Содержание лекций

<p>Тема 1. Срочный рынок: сущность, функции, ключевые игроки, инфраструктура (ПК-8) Понятие рынка производных финансовых инструментов как экономической категории. Причины его возникновения. Функции срочного рынка. Становление срочного рынка в России, его специфика, этапы развития. Участники рынка производных финансовых инструментов. Непосредственные игроки срочного рынка: хеджеры, спекулянты, арбитражеры. Инфраструктура рынка стандартных контрактов.</p>
<p>Тема 2. Основные виды производных финансовых инструментов (ПК-9) Причины появления депозитарных расписок. Механизм выпуска и обращения депозитарных расписок. Классификация депозитарных расписок. Уровни депозитарных расписок. Российские депозитарные расписки, механизм выпуска и обращения. Биржевые производные финансовые инструменты. Внебиржевые производные финансовые инструменты. Виды свопов: валютный, процентный, валютно-процентный, товарный, фондовый. Преимущества и недостатки свопов. Форвардный контракт. Варранты, понятие, особенности выпуска и обращения.</p>
<p>Тема 3. Фьючерсный контракт: сущность, особенности обращения (ПК-7) Определение фьючерсного стандартного контракта. Классификация фьючерсных контрактов в зависимости от базисных активов. Спецификация фьючерсного контракта. Маржинальные условия при операциях с фьючерсными контрактами. Понятие страхового (гарантийного) фонда, начальной (первоначальной), вариационной и дополнительной маржи.</p>
<p>Тема 4. Опционный контракт: сущность, виды, внутренняя и временная стоимость (ПК-7) Понятие опционного контракта. Спецификация опционного контракта. Классификация опционов: по основным видам - опцион «колл» и опцион «пут», по срокам исполнения - американский и европейский, по прибыли – «в деньгах», «на деньгах», «без денег». Цена исполнения опционного контракта. Премия опциона. Внутренняя и временная стоимость опциона. Факторы зависимости временной стоимости опционного контракта. Преимущества операций с опционными контрактами.</p>
<p>Тема 5. Ценообразование фьючерсных и опционных контрактов (ПК-9) Ценовая взаимосвязь рынка реального товара и фьючерсного рынка. Понятие базиса, положительный (backwardation) и отрицательный (contango) базис. Ценообразование фьючерсов. Теоретическая цена фьючерсного контракта. Ценообразование опционов. Формула для расчета опционной премии (формула Блэка-Шоулза). Основные допущения при расчете теоретической премии опциона.</p>
<p>Тема 6. Коэффициенты оценки опционов (ПК-8) Коэффициенты оценки опционов (греки). Дельта, гамма, вега или каппа, тета, ро.</p>
<p>Тема 7. Хеджирование фьючерсными и опционными контрактами (ПК-8) Понятие хеджирования, основные хеджеры. Стратегии хеджирования: короткий хедж, длинный хедж, кросс-хедж. Операции спрэда. Связь опционных стратегий с ожиданиями рынка. Базовые стратегии: длинный «колл», короткий «пут», длинный «пут», короткий «колл». Синтетические позиции, основные виды. Комбинированные опционные стратегии. Вертикальный, горизонтальный, диагональный спред. Опционный стрэдл, стрэнгл.</p>
<p>Тема 8. Клиринг и расчеты на биржевом рынке стандартных контрактов (ПК-9) Особенности централизованного клиринга на рынке стандартных контрактов, его отличие от других видов клиринга на фондовом рынке. Функции и роль клиринговой организации на рынке стандартных контрактов. Предварительный (текущий, промежуточный) и ежедневный клиринг. Клиринг с полным, частичным обеспечением, клиринг без обеспечения.</p>

7.2 Содержание практических занятий и лабораторных работ

Тема 1. Срочный рынок: сущность, функции, ключевые игроки, инфраструктура (ПК-8) Форма проведения - дискуссия.
Тема 4. Опционный контракт: сущность, виды, внутренняя и временная стоимость (ПК-7) Защита проекта в виде презентации заданного фьючерсного контракта.
Тема 5. Ценообразование фьючерсных и опционных контрактов (ПК-9) Защита проекта в виде презентации заданного опционного контракта.
Тема 8. Клиринг и расчеты на биржевом рынке стандартных контрактов (ПК-9) Форма проведения - дискуссия.

7.3. Содержание самостоятельной работы

Тема 1. Срочный рынок: сущность, функции, ключевые игроки, инфраструктура (ПК-8) Для более углубленного понимания поставленных проблем студентам необходимо ответить на ряд вопросов: - причины возникновения современного срочного рынка; - ключевые функции срочного рынка; - основные участники рынка стандартных контрактов; - инфраструктура рынка стандартных контрактов.
Тема 2. Основные виды производных финансовых инструментов (ПК-9) Форма проведения - дискуссия. Изучение понятийного аппарата темы, лекционного материала, глав рекомендованных учебников и дополнительных электронных ресурсов.
Тема 3. Фьючерсный контракт: сущность, особенности обращения (ПК-7) Форма проведения семинара – индивидуальное решение практической задачи. Предусматривает решение практической задачи согласно индивидуального варианта и методических указаний на вычисление начальной, вариационной маржи при купле/продаже фьючерсных контрактов на бирже, обоснование полученных результатов на счете брокера. Изучение понятийного аппарата темы, лекционного материала, глав рекомендованных учебников и дополнительных электронных ресурсов. Подготовка спецификации заданного фьючерсного контракта.
Тема 4. Опционный контракт: сущность, виды, внутренняя и временная стоимость (ПК-7) Изучение понятийного аппарата темы, лекционного материала, глав рекомендованных учебников и дополнительных электронных ресурсов. Подготовка спецификации заданного опционного контракта.
Тема 5. Ценообразование фьючерсных и опционных контрактов (ПК-9) Изучение понятийного аппарата темы, лекционного материала, глав рекомендованных учебников и дополнительных электронных ресурсов.
Тема 6. Коэффициенты оценки опционов (ПК-8) Форма проведения - дискуссия. Изучение понятийного аппарата темы, лекционного материала, глав рекомендованных учебников и дополнительных электронных ресурсов. Подготовка к тестированию.

Тема 7. Хеджирование фьючерсными и опционными контрактами (ПК-8)

Форма проведения - тестирование по фьючерсным и опционным контрактам.

Изучение понятийного аппарата темы, лекционного материала, глав рекомендованных учебников и дополнительных электронных ресурсов.

Тема 8. Клиринг и расчеты на биржевом рынке стандартных контрактов (ПК-9)

Изучение понятийного аппарата темы, лекционного материала, глав рекомендованных учебников и дополнительных электронных ресурсов.

7.3.1. Примерные вопросы для самостоятельной подготовки к зачету/экзамену

Приложение 1

7.3.2. Практические задания по дисциплине для самостоятельной подготовки к зачету/экзамену

Приложение 2

7.3.3. Перечень курсовых работ

Не предусмотрено.

7.4. Электронное портфолио обучающегося

Материалы не размещаются.

7.5. Методические рекомендации по выполнению контрольной работы

Не предусмотрена.

7.6 Методические рекомендации по выполнению курсовой работы

Не предусмотрена.

8. ОСОБЕННОСТИ ОРГАНИЗАЦИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ

По заявлению студента

В целях доступности освоения программы для лиц с ограниченными возможностями здоровья при необходимости кафедра обеспечивает следующие условия:

- особый порядок освоения дисциплины, с учетом состояния их здоровья;
- электронные образовательные ресурсы по дисциплине в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья;
- изучение дисциплины по индивидуальному учебному плану (вне зависимости от формы обучения);
- электронное обучение и дистанционные образовательные технологии, которые предусматривают возможности приема-передачи информации в доступных для них формах.
- доступ (удаленный доступ), к современным профессиональным базам данных и информационным справочным системам, состав которых определен РПД.

9. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Сайт библиотеки УрГЭУ

<http://lib.usue.ru/>

Основная литература:

1. Галанов В. А. Производные финансовые инструменты. [Электронный ресурс]:учебник для студентов вузов, обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика». - Москва: ИНФРА -М, 2019. - 221 – Режим доступа: <https://znanium.com/catalog/product/1012374>

2. Иванченко И. С. Производные финансовые инструменты: оценка стоимости деривативов. [Электронный ресурс]:Учебник для вузов. - Москва: Юрайт, 2020. - 261 – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/457041>

3. Шарп У.Ф., Александер Г. Д. Инвестиции. [Электронный ресурс]:Учебник. - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2021. - 1040 – Режим доступа: <https://znanium.com/catalog/product/1149645>

4. Берзон Н. И., Аршавский А. Ю., Галанова А. В., Касаткин Д. М., Красильников А. С., Курочкин С. В., Меньшиков С. М., Столяров А. И. Рынок ценных бумаг. [Электронный ресурс]:Учебник для вузов. - Москва: Юрайт, 2020. - 514 – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/449663>

5. Татьянников В. А., Разумовская Е. А., Решетникова Т. В., Куваева Ю. В., Львова М. И. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс]:учебник для обучающихся вузов по направлениям подготовки УГСН 38.00.00 "Экономика и управление". - Екатеринбург: Издательство Уральского университета, 2019. - 495 – Режим доступа: <http://lib.usue.ru/resource/limit/ump/20/p492906.pdf>

Дополнительная литература:

1. Вайн С. Опционы: Полный курс для профессионалов [Электронный ресурс]:Полный курс для профессионалов. - Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2016. - 438 с. – Режим доступа: <https://znanium.com/catalog/product/915809>

2. Решетников А. И., Решетникова Т. В., Татьянников В. А., Чилимова Т. А. Участники, инструменты, технологии инвестирования на фондовом рынке [Электронный ресурс]:учебное пособие. - Екатеринбург: [Издательство УрГЭУ], 2017. - 132 – Режим доступа: <http://lib.usue.ru/resource/limit/ump/18/p490470.pdf>

3. Татьянников В. А., Зеленин А. О., Казаков И. А. Структурированные финансовые продукты в условиях рыночной неопределенности [Электронный ресурс]:монография. - Екатеринбург: Издательство УрГЭУ, 2022. - 207 – Режим доступа: <http://lib.wbstatic.usue.ru/resource/limit/books/22/m494884.pdf>

Дополнительная литература:

1. Татьянников Производные финансовые инструменты. Курс лекций. Лекция 2. Виды производных финансовых инструментов [Электронный ресурс]:. - [Екатеринбург]: [б. и.], [2019]. - 1 – Режим доступа: <http://lib.wbstatic.usue.ru/201908/38.mp4>

2. Татьянников Производные финансовые инструменты. Курс лекций. Лекция 1. Участники срочного рынка, их функциональные обязанности [Электронный ресурс]:. - [Екатеринбург]: [б. и.], [2019]. - 1 – Режим доступа: <http://lib.wbstatic.usue.ru/201908/39.mp4>

3. Татьянников Производные финансовые инструменты. Курс лекций. Лекция 3. Ценообразование фьючерсных и опционных контрактов. Хеджирование фьючерсными и опционными контрактами [Электронный ресурс]:. - [Екатеринбург]: [б. и.], [2019]. - 1 – Режим доступа: <http://lib.wbstatic.usue.ru/201908/40.mp4>

10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ЛИЦЕНЗИОННОГО ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ОНЛАЙН КУРСОВ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Перечень лицензионного программного обеспечения:

Astra Linux Common Edition. Договор № 1 от 13 июня 2018, акт от 17 декабря 2018. Срок действия лицензии - без ограничения срока.

МойОфис стандартный. Соглашение № СК-281 от 7 июня 2017. Дата заключения - 07.06.2017. Срок действия лицензии - без ограничения срока.

Перечень информационных справочных систем, ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

Справочно-правовая система Гарант. Договор № 58419 от 22 декабря 2015. Срок действия лицензии - без ограничения срока

Справочно-правовая система Консультант +. Срок действия лицензии до 31.12.2023

11. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Реализация учебной дисциплины осуществляется с использованием материально-технической базы УрГЭУ, обеспечивающей проведение всех видов учебных занятий и научно-исследовательской и самостоятельной работы обучающихся:

Специальные помещения представляют собой учебные аудитории для проведения всех видов занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду УрГЭУ.

Все помещения укомплектованы специализированной мебелью и оснащены мультимедийным оборудованием спецоборудованием (информационно-телекоммуникационным, иным компьютерным), доступом к информационно-поисковым, справочно-правовым системам, электронным библиотечным системам, базам данных действующего законодательства, иным информационным ресурсам служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Для проведения занятий лекционного типа презентации и другие учебно-наглядные пособия, обеспечивающие тематические иллюстрации.